

●資金需給

単位：億円	2016年6月2日 需給速報	2016年6月3日 需給予想	2016年6月6日 当社予想
銀行券	200	200	1,000
財政	▲ 49,300	7,500	2,000
資金過不足	▲ 49,100	7,700	3,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			3,400
国債買現			▲ 5,800
国庫短期証買入			
国債買入		4,500	
CP等買入	▲ 200	▲ 100	
貸出支援基金(成)		6,900	▲ 3,900
貸出支援基金(貸)			▲ 200
被災地支援			
社債等買入			
E T F 買入			
国債補完供給			
当預増減	▲ 49,300	15,100	400
当座預金残高	2,816,900	2,832,000	2,832,400
準備預金残高	2,542,800		
積み終了先	2,096,400	6月3日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,096,400	積数	6,300
非準備預金先	274,100	1日平均	500
積み期間 (5/16~6/15) の所要準備額			2,129,200
準備預金進捗率	実績	99.70%	日数
			58.06%

●短期金融市場関連指標

2016/6/2	無担 (速報)			有担 (速報)			短国	東京 レポレート	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.055				-	▲ 0.082	▲ 0.100	0.020	16,562.55	▲ 393.18	109.45-47	108.95-96
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.081						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	0.010	▲ 0.005				-	▲ 0.097						
2W	▲ 0.023	0.000	▲ 0.009				-	▲ 0.103						
3W			0.000				-	▲ 0.114						
1M							-	▲ 0.150						
3M							▲ 0.253	▲ 0.199						
6M							▲ 0.295	▲ 0.215						
1Y							▲ 0.396	▲ 0.221						
									日付	5/26	5/27	5/30	5/31	6/1
日銀当預残									2,837,000	2,849,100	2,846,800	2,867,900	2,866,200	
準備預金残									2,555,800	2,563,800	2,579,000	2,577,300	2,591,800	
マネタリーベース									3,836,800	3,850,000	3,847,100	3,867,300	3,865,000	
無担O/N加重平均									▲ 0.054%	▲ 0.049%	▲ 0.054%	▲ 0.054%	▲ 0.054%	
コール市場残高									68,083	72,789	65,615	53,810	69,426	
									うち無担	50,895	55,314	49,372	39,775	52,129
									うち有担	17,188	17,475	16,243	14,035	17,297

●入札結果

名称	回号	表面 利率	発行 予定額	発行日	償還日	応募額 (億円)	募入額 (億円)	募入 最低額	募入最高利回・利 回較差	素分率	募入 平均価格	募入平均利回・利 回較差	第1非価格 競争入札(億円)
国庫短期証券	611	-	43,500	2016/6/6	2016/9/5	189,943.0	39,544.7	100.0635	▲0.2545%	91.9285%	100.0664	▲0.2661%	3,955.0
10年利付国債	343	0.10%	24,000	2016/6/20	2026/6/20	89,491.0	21,798.00	101.9400	▲0.0920%	39.0439%	101.9600	▲0.0940%	2,181.0

●オペ結果

種類	オファー額 (億円・ 百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付 利率	応札総額 (億円・ 百万ドル)	落札総額 (億円・ 百万ドル)	按分レート ・利回較差 ・価格較差	全取レート ・利回較差 ・価格較差	平均落札レート ・利回較差 ・価格較差	按分 比率
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	8,000	2016/6/6	2016/6/20		3,350	3,350				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	20,000	2016/6/2	2016/6/3		10	10		▲0.600	▲0.600	

●2016年6月3日の予定

*4月の毎月勤労統計調査速報	*米国4月の貿易収支	*米国5月の雇用統計
*6月の日銀当座預金増減要因見込み	*米国4月の製造業新規受注・出荷・在庫	*米国5月のISM非製造業景況指数

◆本資料は信頼できるとされる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。
◆本資料は何かの取引を誘引することを目的としたものではありません。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。
◆金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目論見書をよくお読みください。
セントラル短資株式会社 登録金融機関関東財務局長（登金）第526号 日本証券業協会加入